

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

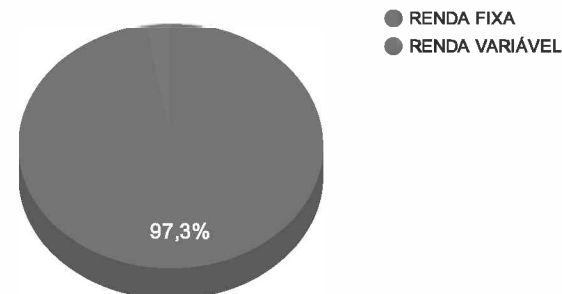
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			6.261.354,04	15,12%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.882.443,00	4,55%	192	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	973.344,55	2,35%	122	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.776.995,89	9,12%	620	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.498.609,77	13,28%	603	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	546.814,67	1,32%	731	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.417.070,36	17,92%	713	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.123.910,43	2,71%	320	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.993.656,89	9,65%	69	1,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.920.489,76	7,05%	244	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.341.720,63	3,24%	588	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	679.392,60	1,64%	787	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.434.381,91	5,88%	758	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.421.678,47	3,43%	98	1,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.126.623,84	2,72%	35	4,36%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	41.398.486,81				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2016)

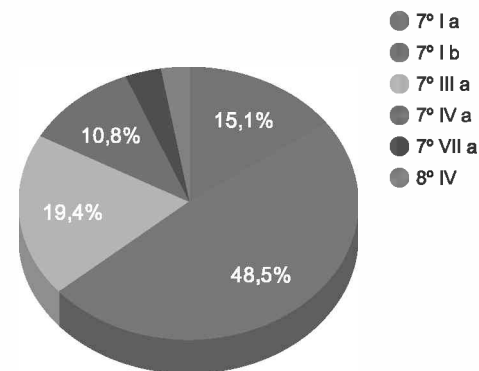
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	30,00%	6.261.354,04	15,12%	6.158.192,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	20.095.278,24	48,54%	603.965,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	35,00%	8.038.057,08	19,42%	6.451.413,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.455.495,14	10,76%	7.964.050,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	1.421.678,47	3,43%	648.245,87
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.069.924,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.069.924,34
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	40.271.862,97	97,28%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.126.623,84	2,72%	943.300,50
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	4.139.848,68
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.069.924,34
Total Renda Variável	30,00%	20,00	1.126.623,84	2,72%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



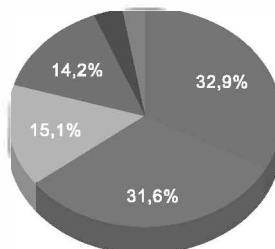
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (dezembro / 2016) ainda não disponíveis.

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2016)

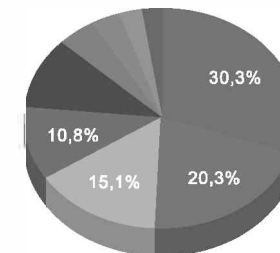
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.628.448,16	32,92%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.084.282,41	31,61%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	6.261.354,04	15,12%
BANCO BRADESCO	5.876.099,89	14,19%
PETRA Corretora	1.421.678,47	3,43%
BRB DTVM	1.126.623,84	2,72%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS...
- TESOURO NACIONAL...
- BANCO BRADESCO
- PETRA Corretora
- BRB DTVM



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	12.534.637,68	30,28%
IMA-B	8.419.099,53	20,34%
TÍTULOS PÚBLICOS	6.261.354,04	15,12%
CDI	4.455.495,14	10,76%
IDKA IPCA 2A	4.323.810,56	10,44%
IRF-M 1	1.882.443,00	4,55%
FIDC - FECHADO	1.421.678,47	3,43%
MULTIMERCADO	1.126.623,84	2,72%
IDKA IPCA 3A	973.344,55	2,35%

- IMA-B 5
- IMA-B
- TÍTULOS PÚBLICOS
- CDI
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- FIDC - FECHADO
- MULTIMER...
- IDKA IPCA 3A



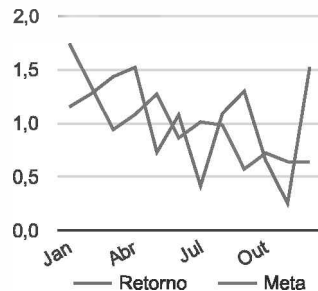
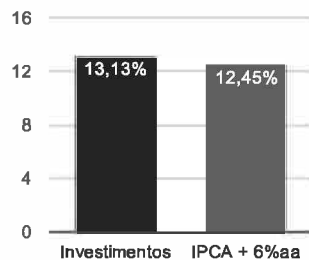
Carteira de Títulos Públicos - base (dezembro / 2016)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2017	27/04/2009	3658	915,328059	1.048,276249	3.348.270,04	3.834.594,52	486.324,48
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2017	20/08/2009	1664	901,008571	1.048,276249	1.499.278,26	1.744.331,68	245.053,42
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2017	07/12/2009	651	920,636489	1.048,276249	599.334,35	682.427,84	83.093,48

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	33.071.387,88	640.835,07	109.167,29	33.990.180,11	387.124,45	1,15%	1,74%	66,23%	1,29%
Fevereiro	33.990.180,11	419.262,77	645.741,62	34.196.641,22	432.939,96	1,27%	1,34%	94,75%	1,24%
Março	34.196.641,22	519.948,26	132.905,97	35.079.217,38	495.533,87	1,43%	0,94%	152,08%	2,00%
Abril	35.079.217,38	438.962,31	123.772,37	35.931.871,95	537.464,63	1,52%	1,08%	141,08%	1,26%
Mai	35.931.871,95	360.619,55	128.902,10	36.426.059,53	262.470,13	0,73%	1,27%	57,12%	1,11%
Junho	36.426.059,53	390.807,33	143.295,82	37.068.211,72	394.640,68	1,08%	0,86%	124,87%	0,91%
Julho	37.068.211,72	713.528,78	113.743,89	37.824.326,96	156.330,35	0,42%	1,01%	41,12%	0,67%
Agosto	37.824.326,96	4.789.728,94	4.510.836,28	38.517.803,59	414.583,97	1,09%	0,98%	111,53%	1,40%
Setembro	38.517.803,59	3.846.861,09	3.568.903,68	39.299.870,71	504.109,71	1,30%	0,57%	229,11%	1,39%
Outubro	39.299.870,71	2.850.948,28	2.543.749,06	39.864.406,80	257.336,87	0,65%	0,72%	89,65%	1,27%
Novembro	39.864.406,80	226.889,82	140.105,84	40.052.831,07	101.640,29	0,25%	0,64%	39,48%	2,42%
Dezembro	40.052.831,07	937.930,54	213.695,06	41.398.486,81	621.420,26	1,52%	0,64%	236,51%	1,73%
Acumulado no ano					4.565.595,17	13,13%	12,45%	105,43%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.344.148,15	0,00	0,00	5.498.609,77	154.461,62	2,89%	3,58%	2,89%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.838.600,72	0,00	0,00	2.920.489,76	81.889,04	2,88%	3,58%	2,88%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.937.591,38	0,00	0,00	3.993.656,89	56.065,51	1,42%	1,49%	1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.316.233,46	0,00	0,00	7.417.070,36	100.836,90	1,38%	1,32%	1,38%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.108.822,73	0,00	0,00	1.123.910,43	15.087,70	1,36%	1,32%	1,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	960.371,84	0,00	0,00	973.344,55	12.972,71	1,35%	1,31%	1,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	540.067,39	0,00	0,00	546.814,67	6.747,28	1,25%	1,06%	1,25%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.731.162,54	0,00	0,00	3.776.995,89	45.833,35	1,23%	1,02%	1,23%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.860.636,55	0,00	0,00	1.882.443,00	21.806,45	1,17%	0,10%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	671.777,75	0,00	0,00	679.392,60	7.614,85	1,13%	0,01%	1,13%
TÍTULOS PÚBLICOS	6.191.881,34	0,00	0,00	6.261.354,04	69.472,70	1,12%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.407.721,71	0,00	0,00	2.434.381,91	26.660,20	1,11%	0,02%	1,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	606.405,32	937.930,54	212.456,90	1.341.720,63	9.841,67	0,64%	0,01%	1,05%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.424.716,46	0,00	1.238,16	1.421.678,47	-1.799,83	-0,13%	0,14%	-0,21%
Total Renda Fixa					607.490,15	1,53%	1,58%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.112.693,73	0,00	0,00	1.126.623,84	13.930,11	1,25%	6,47%	1,25%
				Total Renda Variável	13.930,11	1,25%	6,47%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	6.066.203,12	0,00	0,00	6.261.354,04	195.150,92	3,22%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.255.630,10	0,00	0,00	7.417.070,36	161.440,26	2,23%	2,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.378.650,10	0,00	0,00	5.498.609,77	119.959,67	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.694.155,63	0,00	0,00	3.776.995,89	82.840,26	2,24%	2,24%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.513.654,69	2.400.000,00	0,00	3.993.656,89	80.002,20	2,04%	2,25%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.940.815,33	420.000,00	0,00	2.434.381,91	73.566,58	3,12%	3,24%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.213.805,32	0,00	2.400.000,00	1.882.443,00	68.637,68	2,89%	3,18%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.854.864,62	0,00	0,00	2.920.489,76	65.625,14	2,30%	2,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.099.716,29	0,00	0,00	1.123.910,43	24.194,14	2,20%	2,20%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	593.194,30	1.195.768,64	468.999,41	1.341.720,63	21.757,10	2,43%	3,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	657.785,38	0,00	0,00	679.392,60	21.607,22	3,28%	3,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	952.434,01	0,00	0,00	973.344,55	20.910,54	2,20%	2,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	534.962,44	0,00	0,00	546.814,67	11.852,23	2,22%	2,22%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.457.957,54	0,00	28.550,55	1.421.678,47	-7.728,52	-0,53%	-2,49%
				Total Renda Fixa	939.815,42	2,41%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.086.041,83	0,00	0,00	1.126.623,84	40.582,01	3,74%	3,74%
Total Renda Variável					40.582,01	3,74%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.730.245,93	785.400,06	0,00	7.417.070,36	901.424,37	15,08%	15,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.169.689,21	1.500.000,00	0,00	5.498.609,77	828.920,56	24,08%	24,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.395.068,94	953.070,52	0,00	3.776.995,89	428.856,43	14,67%	14,94%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.097.170,20	1.500.000,00	0,00	2.920.489,76	323.319,56	23,61%	24,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.195.414,07	920.000,00	1.000.000,00	2.434.381,91	318.967,84	13,35%	14,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.371.328,88	0,00	3.000.000,00	679.392,60	308.063,72	13,09%	13,88%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.973.881,97	0,00	0,00	6.261.354,04	287.472,07	4,81%	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.342.051,33	2.400.000,00	0,00	3.993.656,89	251.605,56	15,09%	15,33%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.857.330,48	0,00	2.041.741,22	0,00	184.410,74	9,93%	14,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.189.902,26	0,00	388.296,14	973.344,55	171.738,43	15,83%	15,79%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	974.941,44	0,00	0,00	1.123.910,43	148.968,99	15,28%	15,28%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	4.158.128,88	2.400.000,00	1.882.443,00	124.314,12	7,71%	14,53%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.236.129,39	0,00	1.355.767,89	0,00	119.638,50	9,68%	13,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	475.933,80	0,00	0,00	546.814,67	70.880,87	14,89%	14,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	418.984,30	2.919.723,28	2.039.161,15	1.341.720,63	42.174,20	5,54%	13,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.643.315,68	0,00	149.852,58	1.421.678,47	-71.784,63	-4,45%	-13,49%
				Total Renda Fixa	4.438.971,33	12,88%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.126.623,84	126.623,84	12,66%	16,69%
Total Renda Variável					126.623,84		

Microsoft
 VBScript runtime
 error '800a000d'
 Type mismatch:
 'FormatNumber'
 /plataforma/relatorios/uRetornoAnoRV.asp,
 line 143